test-meli-eda

April 9, 2024

```
[2]: import pandas as pd
import datetime as dt
import numpy as np
import missingno as msno
import seaborn as sns
import matplotlib.pyplot as plt
```

Carrega e verifica o tipo de cada coluna no dataframe

```
[116]: df = pd.read_csv('dados.csv')
    df.info()
```

<class 'pandas.core.frame.DataFrame'>
RangeIndex: 150000 entries, 0 to 149999
Data columns (total 20 columns):

Column Non-Null Count Dtype 0 150000 non-null int64 a 1 b 137016 non-null float64 2 137016 non-null float64 3 d 149635 non-null float64 4 150000 non-null float64 е 5 f 149989 non-null float64 6 149806 non-null object g 7 h 150000 non-null int64 8 150000 non-null i object 9 j 150000 non-null object 10 150000 non-null float64 k 149989 non-null float64 11 1 12 m 149635 non-null float64 13 150000 non-null int64 14 o 41143 non-null object 15 p 150000 non-null object 150000 non-null object 16 fecha 150000 non-null 17 monto float64 150000 non-null int64 18 score 19 fraude 150000 non-null int64

dtypes: float64(9), int64(5), object(6)

memory usage: 22.9+ MB

```
[117]: df.head(15)
[117]:
                                                                h \
           a
                    b
                                С
                                      d
                                                 е
                                                       f
                                                           g
                                   20.0
                                         0.444828
                                                     1.0
                                                                5
       0
           4
              0.7685
                        94436.24
                                                          BR
       1
           4
              0.7550
                         9258.50
                                    1.0
                                         0.000000
                                                    33.0
                                                          BR
                                                                0
                       242549.09
       2
           4
              0.7455
                                         0.000000
                                                    19.0
                                                          AR
                                                               23
                                    3.0
       3
           4
              0.7631
                        18923.90
                                   50.0
                                         0.482385
                                                    18.0
                                                          BR
                                                               23
              0.7315
                                                     1.0
                                                          BR
                                                                2
       4
                         5728.68
                                   15.0
                                         0.000000
              0.7359
       5
                        42727.15
                                   50.0
                                         0.000000
                                                    47.0
                                                          BR
       6
              0.5962
                         7121.78
                                    2.0
                                         0.398000
                                                     0.0
                                                          BR
                                                               11
       7
              0.6806
                         1656.95
                                                     0.0
                                                          BR
           4
                                   50.0
                                         1.043077
                                                               11
       8
              0.5893
                       311762.23
                                    6.0
                                         0.000000
                                                    15.0
                                                          AR
                                                                2
       9
           4
              0.4759
                        40143.12
                                   50.0
                                         0.000000
                                                    41.0
                                                           AR
                                                                3
       10
           4
              0.8353
                       121926.06
                                   39.0
                                         0.186957
                                                    34.0
                                                          BR
                                                               24
              0.7206
                                         0.230960
                                                     0.0
                                                          BR
                                                                8
       11
                       227874.02
                                    1.0
              0.7688
                                                          BR
       12
                       440434.49
                                   50.0
                                         0.000000
                                                    78.0
                                                               17
       13
              0.7921
                         6555.99
                                   50.0
                                         0.447612
                                                    18.0
                                                          BR
                                                                9
                                                                7
       14
           4 0.7702
                          706.47
                                    1.0
                                         0.153675
                                                     9.0
                                                          BR
                                                               i
                                                                                        k \
       0
           Máquininha Corta Barba Cabelo Peito Perna Pelo...
                                                                cat_8d714cd 0.883598
       1
           Avental Descartavel Manga Longa - 50 Un. Tnt ...
                                                                cat 64b574b
                                                                              0.376019
       2
           Bicicleta Mountain Fire Bird Rodado 29 Alumini...
                                                                cat e9110c5
                                                                             0.516368
       3
           Caneta Delineador Carimbo Olho Gatinho Longo 2...
                                                                cat d06e653 0.154036
       4
                     Resident Evil Operation Raccoon City Ps3
                                                                  cat_6c4cfdc 0.855798
       5
                   Kit Gamer Teclado Hedfone Mouse E Mousepad
                                                                  cat 9d78e2e 0.571502
       6
           Corpinho Avulso Joseph, Josepha Ou Placa Sem Sexo
                                                                  cat_5d6059e
                                                                                0.204991
       7
            Tripa Para Fazer Linguiça - 45 Metros Long Short
                                                                  cat_e686ce3
                                                                                0.569230
       8
           Soldadora Inverter 180 A + Máscara + 2 Esc. Ma...
                                                                cat_bfe5d9b
                                                                             0.897001
       9
           Gamepad Joystick Para Telefono Celular Android...
                                                                cat_5d79fb9
                                                                              0.735790
       10
           Escova Dental Curaprox 5460 Ultra Soft Com 3 U...
                                                                cat_4744ece
                                                                              0.943792
           Par Lanterna Luz De Placa C/ Led Fiat 500 Cone...
                                                                cat_768556e
                                                                              0.530758
       12
           Câmera Sony Mirrorless Alpha A6500 (corpo) Gar...
                                                                cat_d3aa8de
                                                                              0.618222
           Filtro Ar Motor Audi A3 Vw Golf Mk7 Após 2012 ...
       13
                                                                cat_ca18469
                                                                              0.132371
       14
                Base Alta Cobertura Nº4 Bege Essenze Di Pozzi cat 708c94b 0.269991
                 1
                         m
                                  0
                                     p
                                                       fecha
                                                                 monto
                                                                        score
                                                                                fraude
            240.0
                                     N
       0
                     102.0
                             1
                                NaN
                                        2020-03-27 11:51:16
                                                                  5.64
                                                                            66
                                                                                     0
                                  Y
                                                                                     0
       1
           4008.0
                       0.0
                            1
                                     N
                                        2020-04-15 19:58:08
                                                                124.71
                                                                            72
       2
           1779.0
                      77.0
                            1
                               {\tt NaN}
                                     N
                                        2020-03-25 18:13:38
                                                                339.32
                                                                            95
                                                                                     0
       3
           1704.0 1147.0
                            1
                               NaN
                                     Y
                                        2020-04-16 16:03:10
                                                                  3.54
                                                                             2
                                                                                     0
       4
           1025.0
                     150.0
                            1
                               {\tt NaN}
                                     N
                                        2020-04-02 10:24:45
                                                                  3.53
                                                                            76
                                                                                     0
       5
           2798.0
                     506.0
                                     Y
                                        2020-04-13 18:42:28
                                                                 28.00
                                                                            32
                                                                                     0
                            1
                                {\tt NaN}
       6
            127.0
                     125.0
                            0
                                NaN
                                     N
                                        2020-03-22 19:20:24
                                                                 10.56
                                                                            71
                                                                                     0
       7
            363.0
                                        2020-04-12 11:49:54
                                                                            81
                                                                                      0
                     224.0
                                NaN
                                                                  6.13
```

```
8
    4661.0
              826.0
                                  2020-04-20 22:58:52
                                                            142.71
                                                                        64
                                                                                  0
                            Y
                               Y
    4701.0
                                   2020-03-11 15:06:38
                                                                                  0
9
              940.0
                      1
                         NaN
                               Y
                                                             30.48
                                                                        60
10
    3248.0
              132.0
                      1
                            Y
                               Y
                                   2020-03-15 19:18:50
                                                             14.85
                                                                        10
                                                                                  0
    2640.0
                         NaN
                               N
                                   2020-04-19 17:07:37
                                                             23.79
                                                                        24
                                                                                  0
11
                 0.0
                      1
                                                                                  0
12
    4970.0
             1580.0
                      1
                         NaN
                               Y
                                   2020-03-16 11:49:05
                                                          1138.64
                                                                        83
13
    5513.0
             1060.0
                               Y
                                  2020-04-02 22:30:29
                                                                                  0
                      1
                            Y
                                                              7.89
                                                                        50
                                  2020-03-20 15:42:14
                                                                                  0
14
    3199.0
                 0.0
                               N
                                                              9.19
                      1
                         NaN
                                                                        60
```

Transforma a coluna "fecha" para o formato datetime. Cria a coluna hora que indica a hora da compra.

```
[118]: df = df.assign(fecha = df.fecha.apply(lambda x:dt.datetime.strptime(x, \( \to \) "%Y-\( \m' \) df "\( \m' \) "\( \m' \) df = df.assign(hora = df.fecha.dt.hour+df.fecha.dt.minute/60)
```

Aqui vamos criar duas listas para identificar colunas categóricas e numéricas.

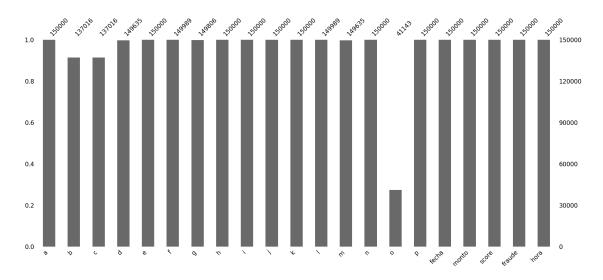
```
[6]: cat_columns = ['a', 'g', 'i', 'j', 'o', 'n', 'p']
num_cols = ['b', 'c', 'd', 'e', 'f', 'h', 'k', 'l', 'm', 'monto', 'hora']
```

0.0.1 Análise de Dados faltantes

Dentre todas as colunas, somente as colunas $\mathbf{b}, \mathbf{c} \in \mathbf{o}$ contém dados faltantes.

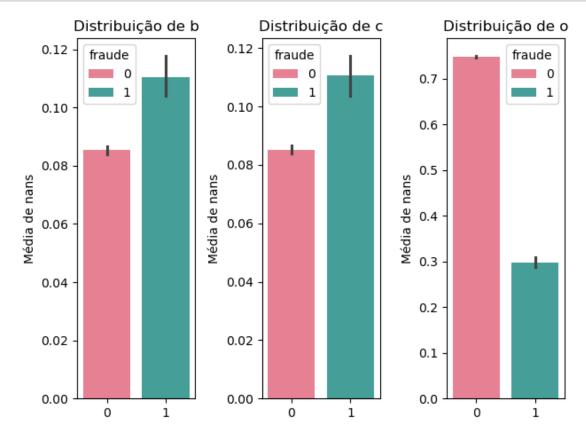
```
[7]: msno.bar(df)
```

[7]: <Axes: >



A proporção de dados faltantes pode ser um fator discriminativo. De fato, observando o plot abaixo, verificamos que a proporção de dados faltantes em $\bf b$ e em $\bf c$ para fraudes é maior. O

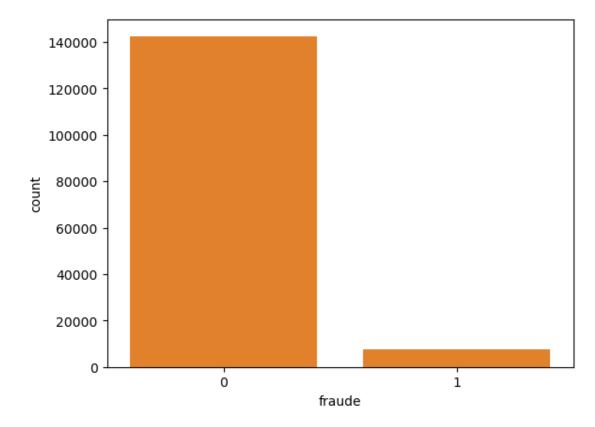
inverso acontece com \mathbf{o} , onde a média de dados faltantes é menos da metade quando o pagamento é uma fraude.



0.0.2 Proporção de fraudes

É comum que as bases de treinamento de fraudes exibam desequilíbrio, o que pode afetar a eficácia dos modelos de detecção. Nesse contexto, diversos métodos de oversampling e undersampling podem ser empregados para lidar com esse desafio, buscando garantir uma representação adequada das classes. Considerando que uma proporção de 5% não é considerada prejudicial, podemos adotar estratégias para ajustar os pesos dos modelos, visando mitigar o impacto do desbalanceamento e melhorar a capacidade de identificação de fraudes de forma mais precisa e eficiente.

label 0: 95.0 % of datapoints label 1: 5.0 % of datapoints

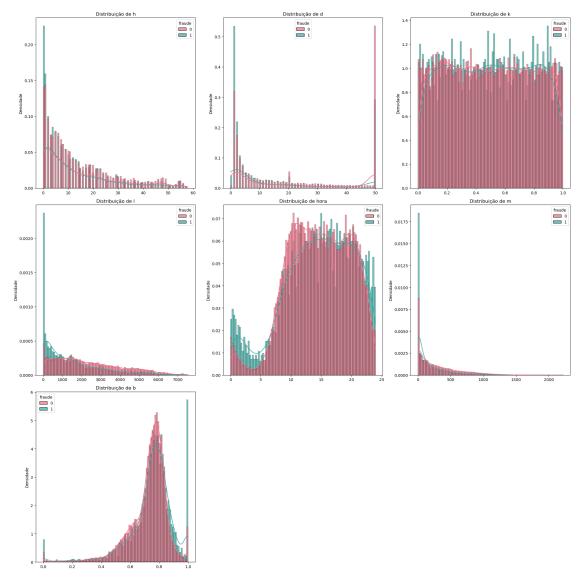


0.0.3 Distribuição das colunas numéricas

```
[10]: plt.figure(figsize=(20, 20))
      for col in num_cols:
           plt.subplot(4, 3, num_cols.index(col) + 1, alpha=0.7)
           sns.histplot(df[col], kde=True, color='blue')
           plt.title(f'Distribuição de {col}')
           plt.xlabel('')
           plt.ylabel('Densidade')
      plt.tight_layout()
      plt.show();
                       Distribuição de b
                                                    Distribuição de o
                                                                                Distribuição de d
```

Para algumas colunas, a visualização não está clara. Portanto, vamos aplicar a escala logarítmica

para melhorar a compreensão.



Comparar a densidade da distribuição para o caso de fraude e não-fraudes nos ajudar a entender algumas diferenças de comportamento: - **Hora**: As probabilidades de fraude aumentam durante a noite; - **l**, **h**, **d** e **m**: Com valores mais baixos, as chances de ocorrência de fraudes aumentam; - **b**: As probabilidades de fraude aumentam quando o valor é igual a 1.

Distribuições log-normais

```
[14]: plt.figure(figsize=(20, 20))

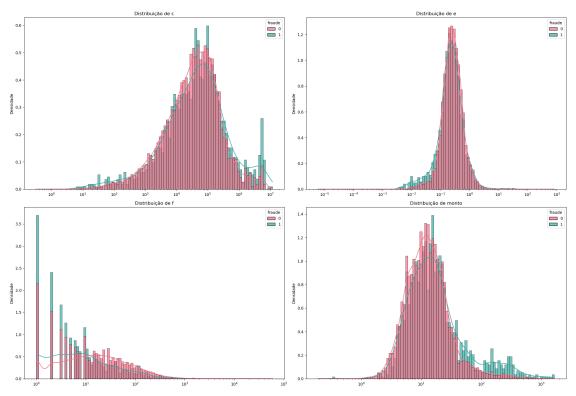
# Fazendo o replace nas colunas especificadas

df_temp = df.replace({col: {0: pd.NA} for col in log_nums_cols}).dropna()

for col in log_nums_cols:
    plt.subplot(3, 2, log_nums_cols.index(col) + 1)
    sns.histplot(data=df_temp, x=col, hue='fraude', kde=True, bins=100, alpha=0.

47, palette='husl', stat='density', common_norm=False, log_scale=True)
    plt.title(f'Distribuição de {col}')
    plt.xlabel('')
    plt.ylabel('Densidade')

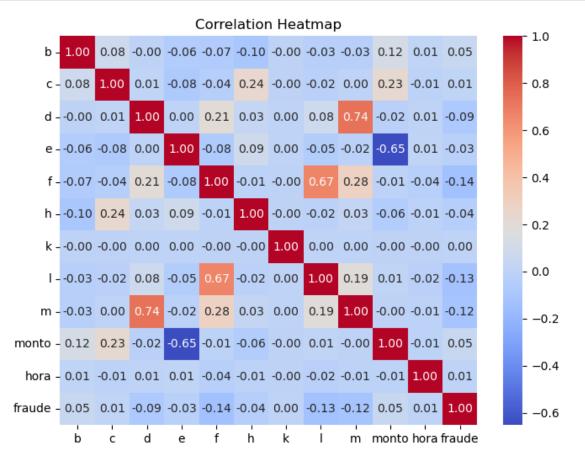
plt.tight_layout()
plt.show()
```



- monto As chances de fraude aumentam com valores mais altos;
- f As chances de fraude aumentam com valores mais baixos.

0.0.4 Estudo de Correlação

```
[56]: plt.figure(figsize=(8, 6))
   df_corr = df[num_cols+['fraude']].corr('spearman')
   sns.heatmap(df_corr, annot=True, cmap='coolwarm', fmt=".2f")
   plt.title('Correlation Heatmap')
   plt.show()
```



```
[74]: muito_forte = 0.8
  forte = 0.6
  moderada = 0.4
  fraca = 0.20

df_corr_upper = df_corr.where(np.triu(np.ones(df_corr.shape), k=1).astype(bool))
  correlacoes = df_corr_upper.unstack().sort_values(ascending=False)

# Filtra as correlações muito fortes
```

```
Series([], dtype: float64)
Correlações fortes (entre 0.6 e 0.79 ):
m d
        0.735300
1 f
        0.669363
dtype: float64
Correlações moderadas (entre 0.4 e 0.59):
Series([], dtype: float64)
Correlações fracas (entre 0.20 e 0.39:
m
       f
            0.284475
       С
            0.242640
monto c
            0.230002
f
       d
            0.210739
dtype: float64
```

A análise de correlação é útil para eliminar variáveis redundantes ou irrelevantes do conjunto de dados, o que pode melhorar o desempenho do modelo e reduzir a complexidade computacional. No entanto, é importante observar que a correlação não implica causalidade. Mesmo que duas variáveis estejam fortemente correlacionadas, isso não significa necessariamente que uma causa a outra. A correlação apenas descreve a relação estatística entre as variáveis, e é necessário realizar análises adicionais para determinar a relação causal, se houver.

0.0.5 Análise Temporal

```
[17]: df['data dia'] = df['fecha'].dt.strftime('%Y-%m-%d')
      print("Essa base contém ", len(df), "pagamentos")
      print("A data mais antiga é", min(df["data_dia"]))
      print("A data mais recente é", max(df["data_dia"]))
     Essa base contém 150000 pagamentos
     A data mais antiga é 2020-03-08
     A data mais recente é 2020-04-21
[18]: df_conversao = df.groupby(["data_dia", "fraude"]).agg({"monto": 'sum'}).
       →reset_index()
      df_conversao
[18]:
           data_dia fraude
                                  monto
         2020-03-08
                           0 113830.82
      1
         2020-03-08
                               9798.05
                           1
         2020-03-09
                           0 190010.34
      2
      3
         2020-03-09
                             14666.02
                           1
                           0 182384.29
      4
         2020-03-10
      85 2020-04-19
                          1
                              9028.48
                          0 208400.31
      86 2020-04-20
      87 2020-04-20
                             23163.98
      88 2020-04-21
                           0 193130.16
      89 2020-04-21
                           1
                             17321.24
      [90 rows x 3 columns]
[19]: import plotly.graph_objs as go
      soma_fraudes = df[df['fraude'] == 1].groupby('data_dia')['monto'].sum()
      soma_nao_fraudes = df[df['fraude'] == 0].groupby('data_dia')['monto'].sum()
      # Plotando o gráfico com Plotly
      fig = go.Figure()
      fig.add_trace(go.Bar(x=soma_fraudes.index, y=soma_fraudes, name='Fraudes'))
      fig.add_trace(go.Bar(x=soma_nao_fraudes.index, y=soma_nao_fraudes, name='Nãou

→Fraudes'))
      fig.update_layout(title='Soma do Montante por Dia',
                        xaxis_title='Data Dia',
                        yaxis_title='Soma',
                        barmode='stack')
```

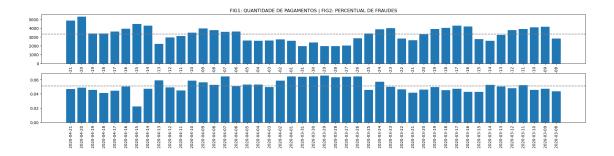
```
fig.show()
```

Durante a análise do gráfico que representa o percentual de fraudes por dia, foi observado que em determinados períodos temporais (21-03, 03-04, 15-04), a incidência de fraudes foi significativamente reduzida, denotando um baixo volume de ocorrências fraudulentas. Em contrapartida, em outras janelas temporais, verificou-se uma elevação considerável no número de fraudes registradas (01-04 por exemplo), indicando a presença de períodos com uma incidência substancialmente maior de atividades fraudulentas. Esta variabilidade nos níveis de fraudes ao longo do tempo sugere a influência de fatores dinâmicos ou sazonais que podem impactar a segurança e a integridade do sistema ou processo em análise.

```
[33]: df_conversao_dia = df.groupby("data_dia").agg({"j": 'count', "fraude": 'sum'}).
       →reset_index()
     df conversao dia["conversao per"] = df conversao dia["fraude"]/

df_conversao_dia["j"]

     df_conversao_dia=df_conversao_dia.sort_values("data_dia", ascending = False).
       →rename(columns={'j': 'n_pagamentos', 'fraude': 'n_fraudes'})
     plt.figure(figsize=(25, 5))
     # QUANTIDADE DE VENDAS POR PRAÇA:
     plt.subplot(211)
     df_conversao_dia=df_conversao_dia.sort_values("data_dia", ascending = False)
     plt.bar(df_conversao_dia["data_dia"], df_conversao_dia["n_pagamentos"])
     plt.axhline(y=df_conversao_dia.n_pagamentos.mean(), color='gray',__
       →linestyle='--')
     plt.title("FIG1: QUANTIDADE DE PAGAMENTOS | FIG2: PERCENTUAL DE FRAUDES")
     plt.xticks(rotation=90)
     # % CONVERSÃO POR PRAÇA:
     plt.subplot(212)
     plt.xticks(rotation=90)
     plt.bar(df_conversao_dia["data_dia"], df_conversao_dia["conversao_per"])
     plt.axhline(y=df_conversao_dia.conversao_per.mean(), color='gray',_
       →linestyle='--');
```



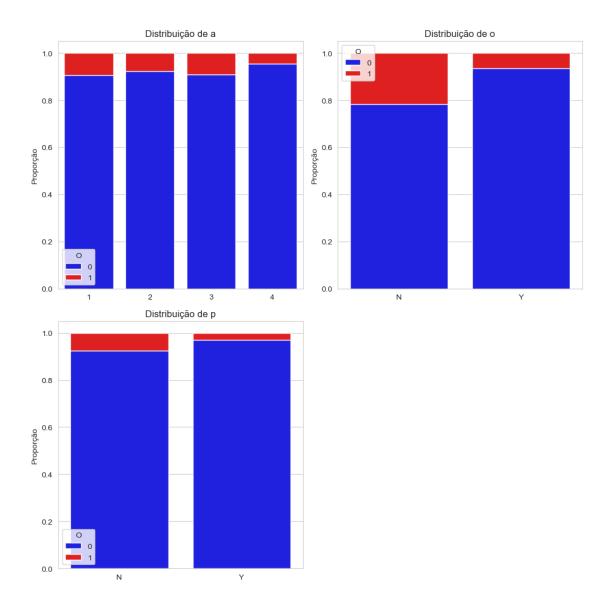
```
[36]: from scipy.stats import pearsonr pearsonr(df_conversao_dia['n_pagamentos'], df_conversao_dia['conversao_per'])
```

[36]: PearsonRResult(statistic=-0.5349408710592065, pvalue=0.0001532036208505364)

Com significância estatística (p-value < 0.05) pode-se dizer que há uma correlação inversa moderada entre o número de pagamentos e o percentual de fraudes por dia. Uma possível explicação é que, quando ocorre um aumento significativo no número de pagamentos, o número de fraudes não crescem na mesma proporção, diminuindo o percentual.

0.0.6 Distribuição das colunas categóricas

```
[133]: plt.figure(figsize=(10, 10))
       # Fazendo o replace nas colunas especificadas
       for i, col in enumerate(['a', 'o', 'p'], start=1):
           df_temp = df.groupby(col)['fraude'].value_counts(normalize=True).unstack().
        →reset index()
           df_temp['fraude'] = df_temp.index
           plt.subplot(2, 2, i)
           sns.barplot(data=df_temp, x=col, y=0, color='b', label='0')
           sns.barplot(data=df_temp, x=col, y=1, color='r', label='1', __
        ⇒bottom=df_temp[0])
           plt.title(f'Distribuição de {col}')
           plt.xlabel('')
           plt.ylabel('Proporção')
           plt.legend(title='0')
       plt.tight_layout()
       plt.show()
```



- a Menor proporção de fraudes para valor igual a 4, em comparação com outros valores;
- \mathbf{o} e \mathbf{p} Menor proporção de fraudes para Y em em comparação com N.

Para uma análise mais completa e para validar a significância estatística das conclusões sobre a diferença de proporções, é comum realizar um teste de hipóteses, como o teste de diferença de proporções z.

0.0.7 Fraudes por Região

```
[312]: df_conversao_regiao = df.groupby("g").agg({"j": 'count', "fraude": 'sum'}).

$\times \text{reset_index()}$
df_conversao_regiao["conversao_per"] = df_conversao_regiao["fraude"]/

$\times \text{df_conversao_regiao["j"]}$
```



Algumas regiões apresentam uma taxa de ocorrência de fraudes consideravelmente elevada, enquanto outras não registram nenhuma incidência de fraude. No entanto, é imprescindível realizar uma avaliação da significância estatística dessa proporção de fraudes por região, visto que muitas delas possuem um baixo volume de transações ou pagamentos, o que pode influenciar na interpretação dos resultados.

```
df_conversao_regiao['p_value'] = p_values
df_conversao_regiao['is_significative'] = df_conversao_regiao['p_value'] < 0.

$\times 0001$

# Exibindo o DataFrame com o p-value para cada país
df_conversao_regiao
```

[54]:	g	$n_{pagamentos}$	${\tt n_fraudes}$	conversao_per	p_value	<pre>is_significative</pre>
6	BR	111628	6162	0.055201	0.000000e+00	True
2	AR	31964	1179	0.036885	0.000000e+00	True
48	US	2273	70	0.030796	0.000000e+00	True
49	UY	2967	29	0.009774	0.000000e+00	True
44	SE	358	15	0.041899	4.113443e-82	True
43	RU	73	6	0.082192	3.947261e-14	True
18	ES	69	5	0.072464	4.119231e-14	True
32	ΜX	236	3	0.012712	3.968030e-65	True
20	FR	18	3	0.166667	7.537842e-03	False
14	DE	9	3	0.333333	5.078125e-01	False
34	NL	2	2	1.000000	5.000000e-01	False
16	EC	4	2	0.500000	1.000000e+00	False
30	KR	1	1	1.000000	1.000000e+00	False
19	FI	1	1	1.000000	1.000000e+00	False
36	NZ	3	1	0.333333	1.000000e+00	False
41	PT	13	1	0.076923	3.417969e-03	False
12	CO	64	1	0.015625	7.047314e-18	True
10	CL	9	1	0.111111	3.906250e-02	False
35	NO	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
38	PΕ	5	0	0.000000	6.250000e-02	False
33	NI	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
37	PΑ	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
0	AD	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
39	PH	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
40	PR	2	0	0.000000	5.000000e-01	False
42	PY	4	0	0.000000	1.250000e-01	False
45	TR	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
46	TW	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
47	UA	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
31	LB	2	0	0.000000	5.000000e-01	False
25	HN	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
29	JP	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
28	IT	14	0	0.000000	1.220703e-04	False
3	AU	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
4	BE	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
5	B0	2	0	0.000000	5.000000e-01	False
7	BS	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
8	CA	3	0	0.000000	2.500000e-01	False

9	CH	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
11	CN	3	0	0.000000	2.500000e-01	False
13	CR	2	0	0.000000	5.000000e-01	False
15	DO	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
17	EG	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
21	GB	43	0	0.000000	2.273737e-13	True
22	GE	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
23	GH	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
24	GR	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
1	ΑE	2	0	0.000000	5.000000e-01	False
26	IL	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
27	IN	1	0	0.000000	1.000000e+00	False
50	ZA	1	0	0.000000	1.000000e+00	False

Com base nesta tabela, é possível observar que alguns países apresentam uma significância estatística em relação ao número de fraudes (considerando p-value<0.0001), enquanto outros não. Isso significa que, para esses países, o número de fraudes identificado não é atribuível ao acaso, e podemos assegurar que a proporção indicada é a propoção esperada de fraudes para estes países.

Com base nessas informações, temos o gráfico revisado:

